

BAB I

PENDAHULUAN

A. Latar Belakang

Indonesia merupakan suatu negara yang menganut sistem perekonomian terbuka, artinya bahwa negara tersebut melakukan transaksi ekonomi dengan pihak luar negeri yang disebut dengan perdagangan internasional. Salah satu variabel ekonomi makro terpenting disebut ekspor. Perdagangan internasional merupakan perdagangan antara lalu lintas negara yang mencakup kegiatan ekspor dan impor. Perdagangan internasional dibagi menjadi dua kategori, yaitu perdagangan barang dan perdagangan jasa. Kegiatan perdagangan internasional dilakukan bertujuan untuk meningkatkan standar hidup negara tersebut (Schumacher, 2013).

Ekspor adalah barang dan jasa yang diproduksi didalam negara, kemudian akan dijual keluar negeri (Mankiw, 2006:240). Peran ekspor cukup lebih penting dalam pertumbuhan ekonomi.

Kegiatan ekspor lebih memberikan nilai tambah bagi suatu negara dibandingkan dengan kegiatan impor. Perdagangan internasional menciptakan kesempatan pada semua negara untuk memperoleh kesejahteraan hidup yang lebih baik, karena memberikan kesempatan untuk menspesialisasikan atau mengkhususkan diri dalam melakukan kegiatan yang dimilikinya (Mankiw, 2002: 70).

Salah satu upaya untuk mendorong pertumbuhan ekonomi suatu negara adalah meningkatkan aktifitas ekspor. Pengutamaan ekspor di

Indonesia sejak tahun 1983. Hal ini diwujudkan dengan terbitnya Peraturan Pemerintah Nomor 20 Tahun 1983 Tentang Penyertaan Modal Negara Republik Indonesia untuk Pendirian Perusahaan Persero dalam Bidang Jaminan Kredit Ekspor dan Asuransi Ekspor. Pada tabel 1.1 akan memperlihatkan neraca perdagangan Indonesia pada tahun 2006-2016.

Tabel 1.1 Neraca Perdagangan Indonesia Tahun 2006-2016 (juta USD)

Tahun	Ekspor	Non Migas	Migas	Impor	Non Migas	Migas
2006	97712.85	74762.84	22950.01	-66670.85	-50505.81	-16165.04
2007	110601.39	85729.36	24872.03	-77442.37	-58239.27	-19203.10
2008	131375.35	99654.73	31720.62	-107622.8	-83687.84	-23934.94
2009	112412.54	91796.37	20616.17	-80977.84	-65733.28	-15244.56
2010	148866.47	120208.01	28658.46	118883.83	-93457.74	-25426.09
2011	189432.27	151365.60	38066.67	157216.90	-118500.10	-38716.80
2012	185337.19	149765.76	35571.43	178626.28	-137815.90	-40810.38
2013	180293.99	146705.57	33588.42	176225.32	-132928.34	-43296.98
2014	173759.96	145007.89	28752.07	168285.93	-127704.25	-40581.68
2015	147724.66	130541.01	17183.65	134405.63	-111518.49	-22887.14
2016	143063.89	130172.77	12891.12	128215.22	-110527.44	-17687.78

Sumber: Bank Indonesia dalam Angka 2000-2016

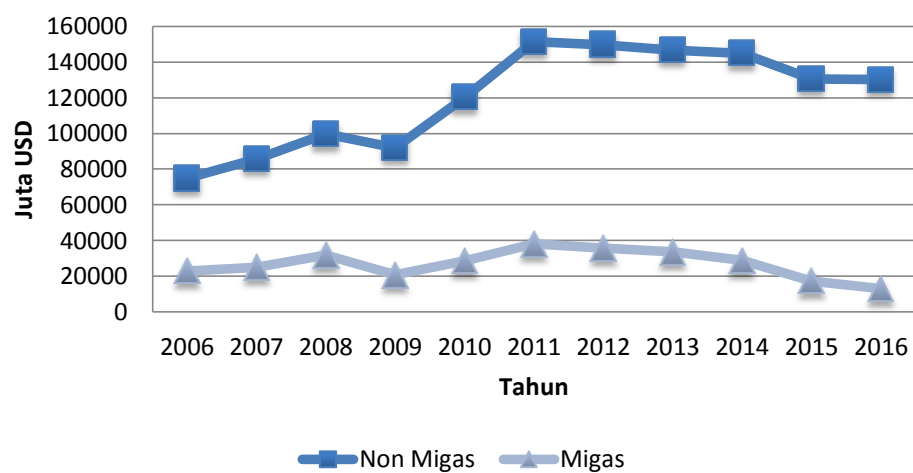
Peran perdagangan internasional Indonesia sangat besar. Hal ini terlihat pada tabel 1.1 dimana neraca perdagangan Indonesia dari tahun 2006-2016 mengalami surplus. Pada tahun 2006 ekspor Indonesia sebesar 97.712,85 juta USD sedangkan impornya -66.670,85 juta USD dapat disimpulkan Indonesia memperoleh surplus sebesar 31.042 juta USD. Pada tahun 2016 ekspor Indonesia sebesar 143.063,89 juta USD sedangkan impornya -128.215,2 juta USD dapat disimpulkan Indonesia memperoleh surplus sebesar 14.848,69 juta USD. Pada neraca perdagangan Indonesia tahun 2006-2016 total ekspor Indonesia selalu mengalami kenaikan hal ini terbukti pada tahun 2006 sebesar 97.712.85 juta USD dan pada tahun 2016 telah mencapai 143.063,89 juta USD.

Total Ekspor masih mendominasi dalam neraca perdagangan (Kumalasari, Fitria Tisna, 2010).

Secara keseluruhan ekspor yang dilakukan oleh Indonesia terdiri dari ekspor migas dan nonmigas. Berikut proporsi ekspor migas dan nonmigas akan ditunjukkan oleh gambar 1.2 di bawah ini.

Grafik 1.1 Proporsi Ekspor Migas dan Nonmigas Indonesia

Tahun 2006-2016



Sumber: Bank Indonesia dalam Angka 2000-2016

Dalam gambar tersebut terlihat bagaimana komposisi ekspor migas dan nonmigas terhadap total ekspor Indonesia. Dari total ekspor Indonesia yang mendominasi adalah pada sektor ekspor nonmigas. Karena dari tahun 2006-2016 mengalami kenaikan yang cukup normal. Dibanding dengan migas perubahan tidak begitu mengalami perkembangan kenaikan atau penurunan yang signifikan tetapi mengalami perkembangan yang normal. Hal ini menunjukkan Indonesia mulai beralih memanfaatkan komoditas nonmigas sebagai prioritas ekspor (Astuti Purnamawati, Sri Fatmawati, 2013).

Nilai tukar (*kurs*) merupakan salah satu faktor yang menentukan dinamika perdagangan internasional. Besarnya ekspor sangat ditentukan oleh nilai kurs ini, karena dalam perdagangan internasional banyak yang menggunakan mata uang US\$ untuk melakukan transaksinya (Mutia Ratna, 2015). Secara teoritis ketika mata uang terdepresiasi maka daya saing barang domestik akan meningkat sehingga dalam jangka panjang akan meningkatkan nilai ekspor.

Selain nilai tukar (*kurs*), terdapat pula faktor lain yang mempengaruhi nilai ekspor, yaitu tingkat pendapatan negara dapat dinyatakan dalam Produk Domestik Bruto (PDB) (Mutia Ratna, 2015). Produk Domestik Bruto (PDB) adalah nilai barang dan jasa yang dihasilkan dalam suatu negara pada suatu tahun tertentu dengan menggunakan faktor-faktor produksi baik milik warga negara maupun milik penduduk negara lain yang berada di negara tersebut. PDB dapat dinilai menurut harga pasar atau harga yang berlaku dan harga tetap atau harga konstan (Mankiw, 2006).

Inflasi merupakan kecenderungan harga naik terus-menerus. Inflasi dapat mengakibatkan penurunan nilai ekspor. Hal ini membuat banyak pelaku usaha mengalami kesulitan dan nilai inflasi yang terus menerus naik menyebabkan kegiatan produktif sangat tidak menguntungkan, investasi produktif akan berkurang dan tingkat kegiatan ekonomi akan menurun. Kenaikan harga menyebabkan barang-barang negara itu tidak dapat bersaing di pasaran internasional sehingga ekspor akan menurun (Sadono Sukirno, 2006)

Dari uraian di atas dapat diketahui jika ekspor merupakan komponen yang penting bagi pertumbuhan ekonomi Indonesia. Lebih lanjut, penelitian ini akan berfokus pada ekspor Indonesia yang dianggap lebih memiliki peranan penting bagi pertumbuhan ekonomi. Terlihat dalam neraca perdagangan Indonesia, ekspor selalu menghasilkan surplus dan mampu mengurangi defisit neraca perdagangan Indonesia. Artinya ekspor masih berpotensi besar menghasilkan pendapatan dan meningkatkan pertumbuhan ekonomi Indonesia. Oleh karena itu, penulis mengemukakan pendapat untuk melakukan penelitian dengan judul **“Analisis Pengaruh Kurs Dollar AS, PDB dan Inflasi Terhadap Ekspor Indonesia Tahun 2006.I – 2016.IV”**.

B. Rumusan Masalah

Berdasarkan penjelasan latar belakang di atas dapat dikemukakan masalah sebagai berikut :

1. Bagaimana pengaruh *kurs* terhadap ekspor Indonesia tahun 2006.I – 2016.IV?.
2. Bagaimana pengaruh PDB terhadap ekspor Indonesia tahun 2006.I – 2016.IV?.
3. Bagaimana pengaruh Inflasi terhadap ekspor Indonesia tahun 2006.I – 2016.IV?.

C. Tujuan Masalah

Tujuan penelitian ini adalah sebagai berikut:

1. Untuk menganalisis pengaruh *kurs* dollar AS terhadap ekspor Indonesia.

2. Untuk menganalisis pengaruh produk domestik bruto (PDB) terhadap ekspor Indonesia.
3. Untuk menganalisis pengaruh inflasi terhadap ekspor Indonesia.

D. Manfaat Penelitian

Manfaat yang bisa diambil dari hasil penelitian ini adalah :

1. Menambah wawasan di tentang ekspor dan faktor yang mempengaruhinya terutama terkait dengan variabel *kurs* dollar AS, PDB dan inflasi terhadap ekspor Indonesia.
2. Diharapkan dapat menjadi salah satu acuan dalam melakukan penelitian yang akan dilakukan selanjutnya.

E. Metode Penelitian

1. Jenis dan Sumber Data

Jenis data dalam penelitian ini adalah data kuantitatif yang berupa data sekunder *time series* tahunan yaitu variabel *kurs*, PDB dan inflasi terhadap ekspor Indonesia. Data *time series* adalah data satu objek yang meliputi beberapa periode waktu (bisa kuartalan, tahunan, dan seterusnya). Data dalam penelitian ini diperoleh dari Badan Pusat Statistik Indonesia dan Bank Indonesia.

2. Alat dan Metode Analisis

Dalam penelitian ini data yang telah terkumpul kemudian diolah dan dianalisis dengan menggunakan teknik analisa statistik guna

mempermudah penarikan kesimpulan. Analisis data menggunakan metode *Partial Adjustment Model* (PAM). Teknik ini dipergunakan untuk mengetahui atau mendapatkan gambaran mengenai pengaruh *kurs*, PDB dan inflasi terhadap ekspor Indonesia tahun 2006.I – 2016.IV. Pengolahan data dilakukan dengan program *Econometric Views* (E-Views). Metode dalam penelitian ini mereplikasi model dari jurnal “Analisis Beberapa Faktor Yang Mempengaruhi Ekspor Kerajinan Ukiran Kayu Indonesia ke Amerika Serikat Tahun 1996-2012” yang ditulis oleh Ari dan Meydianawathi 2014 sebagai berikut:

$$Exp = a + \beta_1 PDB_{AS} + \beta_2 Infl + \beta_3 Invest + \beta_4 Kurs + e_i$$

Keterangan :

Exp = Ekspor kerajinan ukiran kayu Indonesia

a = Konstanta

PDB_{AS} = PDB Amerika Serikat

Infl = Inflasi

Invest = Investasi

$Kurs$ = $Kurs$ dollar Amerika Serikat

e_i = *Error*

Penulis disini mengemukakan model replikasi sebagai berikut:

Model PAM dalam penelitian ini sebagai berikut:

- a. Model penyesuaian parsial memformulasikan fungsi jangka panjang sebagai berikut:

$$EKS_t^* = \beta_0 + \beta_1 KURS_t + \beta_2 PDB_t + \beta_3 INF_t + u_t$$

Keterangan :

EKS = Ekspor Indonesia (juta USD)

$KURS$ = $Kurs$ Dollar AS (rupiah/USD)

PDB = Produk Domestik Bruto (milyar rupiah)

INF = Inflasi (persen)

β_0 = Konstanta

$\beta_1\beta_2\beta_3$ = Koefisien Regresi

u_t = *Error Term*

- b. Sedangkan perilaku penyesuaian parsialnya diformulasikan dengan persamaan sebagai berikut:

$$EKS_t - EKS_{t-1} = \delta(EKS^*_t - EKS_{t-1})$$

Dimana δ adalah koefisien penyesuaian parsial ($0 < \delta \leq 1$), yang karenanya memiliki nilai ($0 < \delta \leq 1$); $EKS_t - EKS_{t-1}$ adalah penyesuaian aktual; sementara $EKS_t - EKS_{t-1}$ adalah penyesuaian yang diinginkan.

- c. Penataan dan substitusi persamaan *adjustment*

$$EKS_t - EKS_{t-1} = \delta(EKS^*_t - EKS_{t-1})$$

$$EKS_t - EKS_{t-1} = \delta EKS^*_t + EKS_{t-1}$$

$$EKS_t = \delta EKS^*_t + EKS_{t-1} - \delta EKS_{t-1}$$

$$EKS_t = \delta EKS^*_t + (1 - \delta) EKS_{t-1}$$

Substitusi:

$$EKS_t = \delta(\beta_0 + \beta_1 KURS_t + \beta_2 PDB_t + \beta_3 INF_t + u_t) + (1 - \delta) EKS_{t-1}$$

$$EKS_t = \delta\beta_0 + \delta\beta_1 KURS_t + \delta\beta_2 PDB_t + \delta\beta_3 INF_t + \delta u_t + (1 - \delta) EKS_{t-1}$$

- d. Parameterisasi model jangka pendek dalam penelitian ini sebagai berikut:

$$EKS_t = \alpha_0 + \alpha_1 KURS + \alpha_2 PDB + \alpha_3 INF + \lambda EKS_{t-1} + v_t$$

Dimana:

$$\alpha_0 = \delta\beta_0, \alpha_1 = \delta\beta_1, \alpha_2 = \delta\beta_2, \alpha_3 = \delta\beta_3, \lambda = (1 - \delta), v_t = \delta u_t$$

Guna menguji kevaliditas model maka dilakukan Uji Asumsi Klasik.

Uji ini dilakukan agar hasil analisis regresi menunjukkan hubungan yang valid.

3. Uji Asumsi Klasik

a. Uji Multikolinieritas

Uji multikolinieritas digunakan untuk mengetahui apakah ada hubungan atau korelasi di antara variabel satu atau lebih variabel bebas pada model regresi. Pada model regresi yang baik seharusnya antar variabel independen tidak terjadi korelasi. Untuk mendeteksi ada atau tidaknya multikolinieritas dalam model regresi dapat dilihat dari tolerance value atau VIF, jika nilai $VIF > 10$ atau Tolerance $< 0,10$ maka hal ini menunjukkan indikasi model regresi terdapat masalah multikolinieritas. Untuk mengatasi gejala ini maka dapat dilakukan membuang variabel yang dapat menimbulkan gejala multikolinieritas atau juga menambah variabel baru dalam penelitian (Utomo, 2015: 162).

b. Uji Normalitas *Residual*,

Asumsi normalitas gangguan U_t merupakan salah satu tahap yang penting, mengingat uji validitas pengaruh variabel

independen baik secara serempak (uji F) maupun sendiri-sendiri (uji t) dan estimasi nilai variabel dependen mensyaratkan hal ini. Apabila asumsi ini tidak terpenuhi maka kedua uji dan estimasi variabel dependen adalah tidak valid untuk sampel kecil atau tertentu. Uji normalitas bertujuan untuk menguji apakah dalam model regresi variabel berdistribusi secara normal. Uji normalitas yang digunakan adalah uji Jaque Bera dengan cara ringkas. Dengan hipotesis pengujiannya adalah sebagai berikut:

H_0 : distribusi ut normal

H_a : distribusi ut tidak normal

Hasil dari pengujian ini kemudian dibandingkan dengan nilai signifikansi (α). Jika nilai probabilitas $JB > \alpha$, maka dapat disimpulkan distribusi ut normal. Namun sebaliknya jika probabilitas $JB \leq \alpha$ maka disimpulkan bahwa distribusi ut tidak normal (Utomo, 2015: 168).

c. Uji Autokorelasi

Uji Autokorelasi bertujuan untuk menguji apakah dalam suatu model regresi linier ada korelasi antara kesalahan pengganggu pada periode t dengan kesalahan t-1. Jika terjadi korelasi maka disebut terjadi problem autokorelasi. Model regresi yang baik adalah yang bebas autokorelasi. Diagnosis ada atau tidaknya gejala autokorelasi dalam penelitian ini dilakukan dengan cara ringkas

dengan melihat pada pengujian Bruesch Godfrey. Dengan hipotesis sebagai berikut:

Ho : tidak terdapat masalah autokorelasi dalam model

Ha : terdapat masalah autokorelasi dalam model

Hasil pengujian kemudian dibandingkan dengan nilai signifikansi (α). Jika probabilitas $x^2 \leq \alpha$ maka Ho ditolak, maka dapat disimpulkan bahwa terdapat masalah autokorelasi dalam model, dan sebaliknya jika $x^2 > \alpha$, maka Ho diterima yang berarti tidak terdapat masalah pada model (Utomo, 2015: 192).

d. Uji Heteroskedastisitas,

Uji Heteroskedastisitas bertujuan untuk menguji apakah dalam model regresi terjadi ketidaksamaan *variance* dari residual satu pengamatan ke pengamatan yang lain. Untuk menguji keberadaan masalah heteroskedastisitas dalam penelitian ini, digunakan cara ringkas Uji White dengan hipotesis sebagai berikut:

Ho : tidak terdapat masalah heteroskedastisitas dalam model

Ha : terdapat masalah heteroskedastisitas dalam model

Kemudian hasil pengujian ini dibandingkan dengan nilai signifikansi (α). Jika probabilitas $x^2 \leq \alpha$, maka Ho ditolak yang berarti dapat ditarik kesimpulan bahwa terdapat masalah heteroskedastisitas dalam model. Namun sebaliknya, jika $x^2 > \alpha$, maka Ho diterima, yang berarti tidak terdapat masalah heteroskedastisitas dalam model (Utomo, 2015: 182).

e. Uji Spesifikasi Model

Uji spesifikasi model pada dasarnya digunakan untuk asumsi tentang linearitas model, sehingga sering disebut uji linearitas model. Pada penelitian ini digunakan cara ringkas uji Ramsey Reset dengan hipotesis sebagai berikut:

H_0 : model linier atau spesifikasi model tepat

H_a : model tidak linier atau spesifikasi model tidak tepat

Hasil pengujian ini kemudian akan dibandingkan dengan nilai signifikansi (α). Jika nilai signifikansi statistik $F > \alpha$, maka dapat disimpulkan bahwa model linier atau spesifikasi model tepat. Namun sebaliknya jika nilai signifikansi statistik $F \leq \alpha$, maka dapat disimpulkan model tidak linier atau spesifikasi model tidak tepat (Utomo, 2015: 202).

4. Uji Kebaikan Model

a. Uji F Statistik (*F Test*)

Pengujian ini dilakukan untuk mengetahui apakah parameterisasi model yang digunakan eksis atau tidak. untuk mengetahui signifikansi secara umum atau disebut juga uji serempak, untuk mengetahui apakah variabel bebas secara bersama-sama mempengaruhi variabel terikat. Maka dapat dilakukan dengan membandingkan nilai F hitung dengan F tabel. Jika F hitung lebih besar dari F tabel maka disimpulkan secara bersama-sama variabel bebas (*Kurs dollar AS, PDB dan Inflasi*).

Sebelumnya, harus ditentukan terlebih dahulu hipotesis pengujiannya sebagai berikut :

$H_0 = \beta_1 = \beta_2 = \beta_3 = 0$, model yang dipakai tidak eksis

$H_a = \beta_1 \neq \beta_2 \neq \beta_3 \neq 0$, model yang dipakai eksis

Hasil dari pengujian ini kemudian akan dibandingkan dengan nilai signifikansi (α). Jika nilai signifikansi statistik $F \leq \alpha$, maka model yang dipakai eksis. Namun jika nilai signifikansi statistik $F > \alpha$ maka model yang dipakai tidak eksis (Utomo, 155).

b. Uji R Square (Koefisien Determinasi Majemuk)

Koefisien determinasi menunjukkan daya ramal dari model statistik terpilih (Utomo, 2015: 150), digunakan untuk menunjukkan seberapa besar presentase variasi variabel independen yang digunakan dalam model regresi mampu menjelaskan variasi variabel dependen. Nilai R^2 terletak antara 0 dan 1. Apabila R^2 mendekati 1 maka dapat dikatakan semakin kuat model tersebut menerangkan variasi variabel independen terhadap variabel dependen. Sebaliknya jika R^2 mendekati nol maka semakin lemah variasi variabel independen menerangkan variabel-variabel dependen.

5. Uji Validitas Pengaruh (Uji T)

Pengujian validitas pengaruh digunakan untuk menguji signifikansi secara parsial (masing-masing) variabel independen terhadap variabel dependen untuk itu digunakan nilai probabilitas. Apabila nilai probabilitas kurang dari 0,10 maka dapat disimpulkan variabel

independen memiliki pengaruh yang signifikan terhadap variabel dependen, sedangkan jika nilai probabilitas lebih besar dari 0,10 maka disimpulkan variabel independen tidak signifikan terhadap variabel dependen. Rumusan hipotesis yang hendak diuji adalah sebagai berikut:

$H_0 = \beta_1 = 0$, variabel independen ke i tidak memiliki pengaruh signifikan

$H_a = \beta_1 \neq 0$, variabel independen ke i memiliki pengaruh signifikan

Hasil dari pengujian ini kemudian akan dibandingkan dengan signifikansi (α). Jika nilai signifikansi statistik $t_i \leq \alpha$ maka variabel independen ke i memiliki pengaruh signifikan. Namun jika nilai signifikansi $t_i > \alpha$ maka variabel independen ke i tidak memiliki pengaruh signifikan (Utomo, 2015: 159).

F. Sistematika Penulisan

Sistematika penulisan dari penelitian ini adalah sebagai berikut :

BAB I Pendahuluan

Dalam bab ini berisi tentang latar belakang, rumusan masalah, tujuan penelitian, manfaat penelitian, metode penelitian serta sistematika penulisan.

BAB II Landasan Teori

Dalam bab ini membahas tentang teori-teori yang berhubungan dengan ekspor, nilai tukar (*kurs*), PDB, inflasi dan penelitian terdahulu.

BAB III Metode Penelitian

Dalam bab ini menjelaskan mengenai ruang lingkup penelitian, jenis dan sumber data penelitian, dan metode analisis data.

BAB IV Analisi Data dan Pembahasan

Dalam bab ini menjelaskan tentang pengaruh nilai tukar (*kurs*), PDB, dan inflasi terhadap Ekspor di Indonesia.

BAB V Penutup

Memuat tentang kesimpulan dan saran dari penelitian yang dilakukan.

DAFTAR PUSTAKA**LAMPIRAN**